
Littérature

- ANDRIEU, L., G. COHEN et F. VAZQUEZ-ABAD. 2011, «Gradient-based simulation optimization under probability constraints», *European Journal of Operational Research*, vol. 212, n° 2, p. 345–351.
- BENVENISTE, A., M. MÉTIVIER et P. PRIOURET. 1990, *Adaptive Algorithms and Stochastic Approximation*, Springer Verlag.
- BOULEAU, N. 1986, *Probabilités de l'ingénieur*, Hermann.
- CHEN, H. F., L. GUO et A. J. GAO. 1988, «Convergence and robustness of the robbins-monro algorithm truncated at randomly varying bounds», *Stoch. Proc. Appl.*, vol. 27, n° 2, p. 217–231.
- COHEN, G. 2004, «Optimisation des grands systèmes», Unpublished lecture notes, Université Paris I. URL <http://cermics.enpc.fr/~cohen-g/documents/ParisIcours-A4-NB.pdf>.
- CULIOLI, J.-C. 1987, *Algorithmes de décomposition/coordination en optimisation stochastique*, thèse de doctorat, École Nationale Supérieure des Mines de Paris.
- CULIOLI, J.-C. et G. COHEN. 1990, «Decomposition-coordination algorithms in stochastic optimization», *SIAM Journal on Control and Optimization*, vol. 28, n° 6, p. 1372–1403.
- CULIOLI, J.-C. et G. COHEN. 1995, «Optimisation stochastique sous contraintes en espérance», *Comptes Rendus de l'Académie des Sciences*, vol. 320, n° I, p. 735–758.
- DACUNHA-CASTELLE, D. et M. DUFLO. 1994, *Probabilités et statistiques. Tome 1 : problèmes à temps fixe*, Masson.
- DELEBECQUE, F. et J.-P. QUADRAT. 1978, «Contribution of stochastic control singular perturbations averaging and team», *IEEE Transaction on Automatic Control*.
- DELYON, B. 2000, «Stochastic approximation with decreasing gain : convergence and asymptotic theory», Unpublished lecture notes, Université de Rennes. URL <http://citeseer.ist.psu.edu/delyon00stochastic.html>.

- DODU, J.-C., M. GOURSAT, A. HERTZ, J.-P. QUADRAT et M. VIOT. 1981, «Méthodes de gradient stochastique pour l'optimisation des investissements», *Bulletin de la Direction des Études et Recherches EDF*, vol. C, n° 2.
- DUFLO, M. 1996, *Algorithmes stochastiques*, Springer Verlag.
- DUFLO, M. 1997, *Random Iterative Models*, Springer Verlag.
- EKELAND, I. et R. TEMAM. 1999, *Convex analysis and variational problems*, SIAM, Philadelphia.
- ERMOLIEV, Y., V. NORKIN et R.-B. WETS. 1995, «The minimization of semicontinuous functions : Mollifier subgradients», *SIAM Journal on Control and Optimization*, vol. 33, n° 1, p. 149–167.
- HENRION, R. 2002, «On the connectedness of probabilistic constraint sets», *Journal of Optimization Theory and Applications*, vol. 112, n° 3, p. 657–663.
- HENRION, R. et C. STRUGAREK. 2008, «Convexity of chance constraints with independent random variables», *Computational Optimization and Applications*, vol. 41, n° 2, p. 263–276.
- HESS, C. 1995, «On the measurability of the conjugate and the subdifferential of a normal integrand», *Journal of Convex Analysis*, vol. 2, p. 153–165.
- KESTEN, H. 1958, «Accelerated stochastic approximation», *Annals Math. Statist.*, vol. 29, p. 41–59.
- KHALIL, H. K. 2002, *Nonlinear Systems*, 3^e éd., Prentice-Hall.
- KIEFER, J. et J. WOLFOWITZ. 1952, «Stochastic estimation of the maximum of a regression function», *Annals Math. Statist.*, vol. 23, p. 462–466.
- KUSHNER, H. J. et D. S. CLARK. 1978, *Stochastic Approximation Methods for Constrained and Unconstrained Systems*, Springer Verlag.
- KUSHNER, H. J. et G. G. YIN. 2003, *Stochastic Approximation and Recursive Algorithms and Applications*, Springer Verlag.
- LAI, T. L. 2003, «Stochastic approximation», *The Annals of Statistics*, vol. 31, n° 2, p. 391–406.
- MATAOUI, M. A. 1990, *Contribution à la décomposition et à l'agrégation des problèmes variationnels*, thèse de doctorat, École Nationale Supérieure des Mines de Paris.
- PLAKHOV, A. et P. CRUZ. 2005, «A stochastic approximation algorithm with multiplicative step size adaptation», *arXiv, math.ST/0503434*.
- POLYAK, B. T. 1976, «Convergence and convergence rate of iterative stochastic algorithms», *Automation and Remote Control*, vol. 37, n° 12, p. 1858–1868. Translation : *Avtomatica i Telemekhanika*, No. 12, pp. 83–94, 1976.
- POLYAK, B. T. 1990, «New method of stochastic approximation type», *Automation and Remote Control*, vol. 51, n° 7, p. 937–946. Translation : *Avtomatica i Telemekhanika*, No. 7, pp. 98–107, 1990.
- POLYAK, B. T. et A. B. JUDITSKY. 1992, «Acceleration of stochastic approximation by averaging», *SIAM Journal on Control and Optimization*, vol. 30, n° 4, p. 838–855.

- POLYAK, B. T. et Y. Z. TSYPKIN. 1979, «Adaptative estimation algorithms (convergence, optimality, stability)», *Automation and Remote Control*, vol. 40, n° 3, p. 378–389. Translation : *Avtomatica i Telemekhanika*, No. 3, pp. 71–84, 1979.
- PREKOPA, A. 1995, *Stochastic Programming*, Kluwer, Dordrecht.
- PUTERMAN, M. L. 2009, *Markov decision processes : discrete stochastic dynamic programming*, vol. 414, John Wiley & Sons.
- QUADRAT, J.-P. et M. VIOT. 2000, «Introduction à la commande stochastique - Cours du DEA MMME de l'Université Paris I», <http://www-rocq.inria.fr/metalau/quadrat/ComSto0.9.pdf>.
- ROBBINS, H. et S. MONRO. 1951, «A stochastic approximation method», *Annals Math. Statist.*, vol. 22, p. 400–407.
- ROCKAFELLAR, R. et R.-B. WETS. 1998, *Variational Analysis*, Springer Verlag, Berlin.
- SCHWARTZ, L. 1993, *Analyse IV. Applications à la théorie de la mesure*, Hermann, Paris.
- SHAPIRO, A., D. DENTCHEVA et A. RUSZCZYŃSKI. 2009, *Lectures on Stochastic Programming : Modeling and Theory*, SIAM, Philadelphia.
- STRUGAREK, C. 2006, *Approches variationnelles et autres contributions en optimisation stochastique*, Thèse de doctorat <http://cermics.enpc.fr/theses/>, École Nationale des Ponts et Chaussées.
- VAZQUEZ-ABAD, F. 2006, «Stochastic optimisation», Unpublished lecture notes, University of Melbourne.
- WITSENHAUSEN, H. S. 1968, «A counterexample in stochastic optimum control», *SIAM Journal on Control*, vol. 6, p. 131–147.